



Backtest #5293 · ASC · ASC · GG3_MACD_Momentum (auto)

ROI	Sharpe	Win Rate	Max Drawdown
+18.76%	0.86	66.7%	-16.91%

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$9997.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

Un ROI del +18.76% con Sharpe de 0.86 suena sólido, pero tres operaciones totales son estadísticamente insignificantes; la varianza domina cualquier señal real. La win rate del 66.7% no es fiable con n=3, y un drawdown del 16.91% sugiere exposición concentrada o slippage no modelado. El equipo de capital final (\$11,876) indica un crecimiento, pero sin un universo más amplio o walk-forward validation, esto es anecdótico. El próximo paso obligatorio es expandir el backtest a 100+ trades o simular walk-forward para probar robustez antes de considerar cualquier implementación real.

ADDITIONAL METRICS

CAGR	18.76%
Sortino Ratio	0.77
Turnover	6.05x
Total Trades	3
Initial Capital	\$9997.00
Final Capital	\$11876.09